

金越证券投资基金上市公告书

上市推荐人 湘财证券有限责任公司
金华市信托投资股份有限公司

重要提示

本上市公告书根据《证券投资基金管理暂行办法》及原有投资基金清理规范的有关规定和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制, 本基金管理人及基金托管人愿就本公告书所载资料的真实性、 准确性和完整性负个别及连带责任, 上市公告书的内容由本公司负责解释。 深圳证券交易所对本基金上市及有关事项的审核均不构成对本公告内容的任何保证。 如有投资者购买金越证券投资基金, 应仔细阅读本上市公告书。

摘 要

基金名称:金越证券投资基金

基金简称:基金金越

基金代码:4696

基金份额总额:21096 万份

本次可流通份数:21096 万份

每份基金面值:1.00 元人民币

基金管理人名称:博时基金管理有限公司

基金托管人名称:交通银行

上市推荐人:湘财证券有限责任公司

金华市信托投资股份有限公司

上市地点:深圳证券交易所

上市时间:2000 年 4 月 24 日

一、基金概况

金越证券投资基金是按照《证券投资基金管理暂行办法》、 原有投资基金清理规范的有关要求和《关于浙江省原有投资基金清理规范实施方案的批复》(证监基金字[1999]26 号)由原金信基金、温信基金、盐信基金、金信受益、 浙工受益和绍信受益清理规范合并而成的契约型封闭式投资基金。基金存续期 10 年(自 1992 年 12 月 31 日至 2002 年 12 月 31 日)。

基金发起人为博时基金管理有限公司; 基金管理人为博时基金管理有限公司;基金托管人为交通银行。

基金总份额为 21096 万份基金单位。1999 年 11 月 11 日, 本基金管理人博时基金管理公司正式管理本基金。

本基金管理人根据本基金持有人大会授权, 向中国证券监督管理委员会提出上市、 扩募、 更名、 续期申请, 该申请已获批准。

根据中国证监会《关于金越证券投资基金上市、 扩募、 更名和续期的批复》(证监基金字[2000]18 号)的批复, 经深圳证券交易所(深圳上[2000]31 号)批准, 金越证券投资基金将于 2000 年 4 月 24 日在深圳证券交易所挂牌交易。

基金金越总份额为 21096 万份基金单位, 由于历史原因, 本基金发起人未能持有基金份额, 基金单位全部由公众持有。本次上市流通的份额为 21096 万份基金单位。

基金上市后交易单位每手为 100 份基金单位。

根据中国证监会《关于金越证券投资基金上市、 扩募、 更名和续期的批复》(证监基金字[2000]18 号)的批复, 本基金在上市后 5 - 30 个工作日内, 由原来的 21096 万份基金单位扩募到 5 亿份基金单位。扩募后, 本基金将更名为“裕华证券投资基金”, 基金存续期将延长 5 年(至 2007 年 12 月 31 日)

二、基金持有人结构及前十名持有人

(一)基金持有人结构:本基金全部为公众持有, 共计 21096 万份基金单位。

(二)前十名持有人:(截至 2000 年 4 月 14 日)

序号	名称	份 额	比 例
1	温州贸易有限公司	4102993 份	1.94%
2	温州市威迪贸易有限公司	3438999 份	1.63%
3	黄锦赛	3092081 份	1.47%
4	大鹏证券有限责任公司	3000000 份	1.42%
5	金华信托投资股份有限公司	3000000 份	1.42%
6	温州国际信托投资公司劳服公司	3000000 份	1.42%
7	方贾忠	2953371 份	1.40%
8	刘秀玉	2087500 份	0.99%
9	金华市金正房地产开发有限公司	2000000 份	0.95%
10	金华金信理财有限公司	2000000 份	0.95%

(三)基金持有人总数为:14790 户,其中持有 1000 基金单位以上的基金持有人户数为 13446 户。

三、基金发起人、基金管理人、基金托管人及中介机构简介

(一)基金发起人

博时基金管理有限公司

法定代表人:周道志

注册地址:北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

邮政编码:100005

营业批准号:1000001002998

组织形式:有限责任公司

注册资本:1 亿元人民币

成立日期:1998 年 7 月 13 日

(二)基金管理人

博时基金管理有限公司

法定代表人:周道志

注册地址:北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

邮政编码:100005

营业批准号:1000001002998

组织形式:有限责任公司

注册资本:1 亿元人民币

成立日期:1998 年 7 月 13 日

信息披露负责人:李全 周正清

联系电话:010-65171166 65187078

公司概况:本公司经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准,由中国长城信托投资公司、光大证券有限责任公司、金华市信托投资股份有限公司、国通证券有限责任公司共同发起设立。

公司下设有基金经理部、研究策划部、基金交易部、监察部、行政管理部等部门。此外还设立投资决策委员会和风险控制委员会两个专门机构。

公司现有员工 49 人,其中 31 人具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

公司已经建立健全内部风险控制制度，内部稽核制度、财务管理、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

截止 2000 年 4 月 14 日，博时基金管理有限公司管理基金总资产已达 97.74 亿元。目前，博时基金管理有限公司管理的其他基金有四只，基本情况如下：

基金裕阳

- 1、基金名称：裕阳证券投资基金
- 2、基金成立日期：1998 年 7 月 25 日
- 3、基金单位总份额：20 亿份
- 4、基金资产净值：30.63 亿元
- 5、基金单位净值：1.5314 元

基金裕隆

- 1、基金名称：裕隆证券投资基金
- 2、基金成立日期：1999 年 6 月 15 日
- 3、基金单位总份额：30 亿份
- 4、基金资产净值：40.40 亿元
- 5、基金单位净值：1.3466 元

基金裕元

- 1、基金名称：裕元证券投资基金
- 2、基金接管日期：1999 年 9 月 17 日
- 3、基金单位总份额：15 亿份
- 4、基金资产净值：20.19 亿元
- 5、基金单位净值：1.3461 元

半岛基金

- 1、基金名称：半岛证券投资基金
- 2、基金接管日期：2000 年 3 月 27 日
- 3、基金单位总份额：2 亿份
- 4、基金资产净值：2.45 亿元
- 5、基金单位净值：1.2240 元

(三)基金托管人

交通银行

法定代表人:王明权

注册地址:上海市仙霞路 18 号

邮政编码:200336

联系电话:021-62082517

联系人:金玉凤

组织形式:股份制

注册资本:120 亿元

发展概况:交通银行是一家全国性股份制商业银行,自 1987 年重新组建以来,有效贯彻现代商业银行全面自律、稳健经营、追求效益的经营管理原则,各项业务稳步、健康发展。

财务状况:截至 1998 年末,交通银行总资产已达 4,839.23 亿元,境内行实现利润 25.48 亿元,实现利润总额和人均利润水平名列国内五大银行前列。

基金托管部门设置及员工情况:交通银行总行于 1998 年 6 月获准设立证券投资基金托管部,主要业务部门包括监管交易部、清算核算部、内控巡查部和综合规划部,现有员工 18 人。

托管其他基金的说明:截止 2000 年 4 月 14 日,交通银行现已托管的基金为:

- 1、基金名称:普惠证券投资基金
基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金成立时间:1999年1月27日
- 2、基金名称:安顺证券投资基金
基金管理人:华安基金管理有限公司
基金成立时间:1999年6月22日
- 3、基金名称:汉兴证券投资基金
基金管理人:富国基金管理有限公司
基金成立时间:1999年12月30日

(四)基金上市推荐人

(1)湘财证券有限责任公司

法人代表:陈学荣

注册地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

联系电话:0731-4458115

联系人:毛劲虎

(2)金华市信托投资股份有限公司

法人代表:葛政

注册地址:浙江省金华市西市街111号

联系电话:0579-2114046

联系人:刘伟

(五)财务审计及验资机构:浙江天健会计师事务所

法定代表人:胡少先

注册地址:浙江省杭州市体育场路423号

联系电话:0571-5178168

注册会计师:沈凌波 吴晨瑜

(六)法律顾问:天驰律师事务所

法人代表:刘延岭

注册地址:北京市东城区安外大街208号三利大厦2018室

联系电话:010-64283423

经办律师:杨晓明 刘瑞华

四、基金的沿革

本基金由原“金信基金”、“温信基金”、“盐信基金”、“金信受益”、“绍信受益”、“浙工受益”合并而成,其历史沿革分别如下:

1. 金信基金

浙江金信投资基金是经中国人民银行浙江省分行批准,中国人民银行金华市分行转复,由金华市信托投资股份有限公司于1992年5月发起设立的,分二期募集,基金总额为人民币2000万元,共200万份基金单位,每份基金单位面值为人民币10元,存续期8年,1992年6月1日起至2000年5月31日止。

经中国人民银行金华市分行(金银(1992)222号批准,金华投资基金于1992年8月26日在金华市信托投资公司金华青春路证券营业部上柜交易。

经中国人民银行金华市分行(金银(1993)28号)批准,金信基金于1993年3月实施分红送股、增资配股及拆细方案。方案分两步进行:首先于1993年3月以1992年末的200万份基金单位为基数,按10送1配4的方式增扩,增扩100万份,基金单位总分额增至300万份,同时将每份基金10元面值拆细为每份基金单位1元面值,基金份额增扩至3000万份基金单

位;其次,于1993年6月在前期送配及拆细的基础上,按10送3配12的方式增扩,新增4500万份基金单位,另外向部分法人定向募集2500万份基金单位,基金总份额达1亿份基金单位。

1993年6月金信基金申请清理规范,经中国人民银行浙江省分行(浙银发(1993)580号文件)上报中国人民银行总行,存续期由原来的8年调整为20年。

从1992年至1998年,金信投资基金年均收益率超过16.8%。

2. 温信基金:

温信基金是经温州市人民政府和中国人民银行浙江省分行《关于同意温州市国际信托投资公司设立投资信托基金的批复》(浙银发(1992)284号)于92年6月8日批准设立的。发行规模为1000万元,存续期5年。93年9月经温州市人行同意,首期基金分配采取10送1.5股形式,即送股150万股,规模扩为1150万元。94年10月根据省人行浙银(1994)432号文,将存续期调整为10年。95年又根据省人行《关于同意对温信基金进行规范扩容的批复》(浙银发(1995)256号),于7月17日至8月9日,进行配股、承销,将规模扩容至5000万元。96年度分红采取送股和派现二者择一的形式(十送二或十派二)。投资者全部选择送股,至97年2月底温信基金规模为6000万元,97年度分红也采取送股和派现二者择一的形式(十送三五或十派三五<含税>),至98年2月底,温信基金规模为8100万元,即8100万个基金单位。

93年7月16日,根据浙银发(1993)184号文,温信基金在温州国际信托投资公司证券交易营业部上柜;93年底,根据浙银发(1993)621号文,于94年1月18日在浙江省证券交易中心上市。

3. 盐信基金:

盐信基金是经中国人民银行江苏省分行批准,于1992年5月16日设立的封闭式信托受益基金,封闭期10年(1992年7月1日至2002年6月30日),基金总规模1500万元。基金发起人、基金管理人、基金托管人均为盐城市信托投资公司。基金原名称为“盐城市信托投资公司信托投资受益证券”,发行时每份面值为1000元。1993年8月26日,盐信基金拆细为每份面值1元,并在本公司柜台上柜交易,1993年12月28日,经武汉证券交易中心批准,以“盐城基金”名义在该中心上柜交易。1999年9月20日,盐信基金在武汉证交中心停牌。

93年—98年,年均分红率超过16%。

4. 金信受益:

金信受益,全称为“金华市信托投资公司专项信托受益券”,1991年11月15日,经中国人民银行浙江省分行批准,中国人民银行金华市分行转复,金华市信托公司设立并发行专项信托受益证券500万元,面值为100元、500元、1000元三种,期限三年,(1992年1月1日至1994年12月31日),所筹500万元资金中,300万元投资于浙江康恩贝制药有限公司,200万元投资于浙江武义好来西股份有限公司。

1993年11月27日,经人行(1993)620号文批准,将存续期调整为10年,1992年1月1日至2001年12月31日;更名为“金华市信托投资股份有限公司信托受益券”;修改信托受益证券章程,取消原有“专项投资”的限制,可选择符合国家产业政策的其他项目;将原三种面值的受益券拆细为1元面值,合500万份。

1994年1月5日,经省人行〔1993〕657号文批准,金华市信托投资股份有限公司信托受益券在浙江省证券交易中心挂牌交易,简称“金信受益”。

1997年1月,金信受益到期收回对康恩贝、好来西的投资,将200万元投入金华制药厂。现金信信托受益证券全部资产均调整为现金、国债和上市公司流通股组成的高流动性资产。

金信受益1992年—1998年年均收益率约15%。

5. 绍信受益:

绍信受益证券是1992年5月11日经中国人民银行绍兴市分行《关于同意绍兴市信托投

资公司设立发行专项信托受益债券的批复》(人银发字(1992)82号)批准设立的封闭式信托受益凭证,时间三年(1992年5月21日—1995年5月31日),证券总规模500万元,发行年利率为9%,为固定利率,如投资效益好可以分红,证券发起人、管理人和托管人均均为绍兴市信托投资公司。发行时每张面值500元。1994年2月5日,按照浙江省人民银行《关于同意绍兴市信托投资公司信托受益证券上市的批复》(浙银发(1994)660号),受益证券拆细为每份面值一元,进入浙江省证券交易中心上市交易,简称“绍信受益”证券,规范后的“绍信受益”证券,存续期从原来的三年延长到十年(1992年5月21日—2002年5月31日),收益分配由原来的固定收益和浮动收益两部分组成,改为全部按实际投资收益进行收益分配。

1994年7月4日,绍信受益以每10份送2份的方式分红,并拆细为每份面值一元,总规模达到600万元。

绍信受益设立之初主要投资于能源、交通等基础设施并选择一些符合国家产业政策的高效专门项目。目前逐步转移到债券、股票等。1992年—1998年,年平均分红率达16%。从1994年2月28日在浙江省交易中心上市至1999年9月17日停牌,累计交易量达2000多万元。

6. 浙工受益:

浙江省工商信托投资股份有限公司受益证券(原中国工商银行浙江省信托投资股份有限公司受益证券,简称浙工受益),系根据中国人民银行浙江省分行《关于同意中国工商银行浙江省信托投资公司发行专项信托受益债券的批复》(浙银发(1992)87号)于92年4月发行的试点受益券。通过认购证方式限额认购,全额面向社会,发行面值1000元证券6000份,总面值600万元。发行后全额投入桐庐瑶琳仙境神仙世界项目建设。浙工受益管理人为浙江省工商信托投资股份有限公司,并设立专门管理委员会进行决策,采用独立分帐方式予以核算。

1993年11月经中国人民银行浙江省分行批准,对原章程作了规范化修改,浙工受益证券存续期延长为10年,投资范围扩大至本省旅游景点的深层开发、交通基础设施建设、证券及其它产业投资,受益证券收益分配改为上不封顶、下不保底、收益共享、风险共担的方式。

浙工受益经中国人民银行浙江省分行《关于同意中国工商银行信托投资股份有限公司信托受益证券上市交易点的批复》(浙银发(93)566号)批准,于1993年11月8日起挂牌交易。

根据原有投资基金清理规范的有关要求及《关于浙江省原有投资基金清理规范实施方案的批复》(证监基金(99)26号)精神,以上六只基金(或受益券)进行了规范重组。1999年10月30日召开持有人临时大会,会议通过了清理合并,更换管理人、托管人等有关事项的决议,温信基金、金信基金、浙工受益、盐信基金、金信受益、绍信受益合并为“金越证券投资基金”。1999年11月2日,原基金(或受益券)摘牌。根据持有人大会决议,合并后的“金越证券投资基金”转由博时基金管理有限公司管理。基金管理人更换为博时基金管理有限公司,基金托管人更换为交通银行,基金存续期为十年(1992年12月31日—2002年12月31日)。

五、基金投资组合情况

(一) 基金投资目标

本证券投资基金的主要投资目标,是通过对技术创新类上市公司的投资而实现长期资本增值。同时通过投资组合等措施减少和分散投资风险而确保基金资产的安全。

技术创新类上市公司是指那些具有较强技术创新能力、其技术创新行动已经、正在或将要对企业价值构成一次性或持续累积性提升的上市公司。

技术创新和制度创新一直是经济发展和生产率增长的基本驱动力。创新能力是现代企业核心竞争能力的标志。技术创新包括由技术变化所引起的上市公司营销、管理、技术、市场和企业组织变化或产业竞争格局的变化。

本基金对技术创新类上市公司的投资选择范围包括上述各技术创新类型以及对上市公司

价值产生影响的各个方面。

本基金的投资范围仅限于国内依法公开发行、上市的股票和国债。主要投资对象为技术创新类上市公司的股票和债券。

基金管理人在选择投资对象和建立投资组合时，将把投资对象的良好流动性和投资组合的合理分散性作为重要参考指标。

(二) 投资组合情况

本基金基金资产已于 1999 年 11 月 8 日全部划至本基金的托管人交通银行“金越证券投资基金专户”；11 月 11 日，基金管理人博时基金管理有限公司开始本基金的投资运作。

投资组合情况如下：（截止 2000 年 4 月 14 日，单位：元）

银行存款	6,434,085.27
股票投资	180,781,646.16
债券投资	0.00

(三) 基金经理

本基金由刘小山先生担任基金经理，负责基金的日常投资运作。

刘小山：现年 30 岁，硕士，6 年证券业从业经验，历任君安财务顾问有限公司期货部经理，君安证券有限责任公司资产管理部总经理助理，副总经理，基金经理。现担任基金裕元和基金金越的基金经理。

六、基金契约摘要

(一) 前言

本基金契约是根据《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、原有投资基金清理规范的有关要求和中国证监会的有关规定而订立。

(二) 基金契约的当事人

- 1、基金发起人：博时基金管理有限公司
- 2、基金管理人：博时基金管理有限公司
- 3、基金托管人：交通银行

(三) 基金基本情况

基金名称：金越证券投资基金

基金类型：契约型封闭式（在符合有关规定并经基金持有人大会同意、中国证监会批准后可转型为契约型开放式）

基金投资目标：本证券投资基金的主要投资目标，是通过具有较强技术创新能力的上市公司的投资而实现长期资本增值，是通过减少和分散投资风险而确保基金资产的安全。

基金单位总份额：2.1096 亿份基金单位

每份基金单位面值为人民币 1.00 元

基金存续期限为：1992 年 12 月 31 日—2002 年 12 月 31 日

(四) 基金的沿革（参见本公告书第四条《基金的历史沿革》）

(五) 基金的上市与交易安排

本基金经主管部门批准和基金持有人大会通过，将根据《证券投资基金管理暂行办法》及有关规定申请在深圳证券交易所上市。本基金上市后，将根据交易所的交易规则进行交易。

(六) 基金的托管

基金托管人与基金管理人须按照《证券投资基金管理暂行办法》、基金契约及其他有关规定订立金越证券投资基金托管协议。

(七) 基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资决策、投资组合、投资限制和交易席位租用的原则

1、投资目标

本证券投资基金的主要投资目标，是通过技术创新类上市公司的投资而实现长期资本增值。同时通过投资组合等措施减少和分散投资风险而确保基金资产的安全。

2、投资范围

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

3、投资决策

1) 决策依据

- (1) 上市公司研究。
- (2) 行业发展状况。
- (3) 证券市场的走势。
- (4) 国内国际经济环境。
- (5) 国家有关法律、法规和本基金契约的有关规定。

2) 决策程序

本基金的基金管理人坚持以研究支持投资决策的风格。管理人内部设立研究策划部、基金管理部、基金交易部、监察部等部门，并由总经理及相关人员组成投资决策委员会,以保证基金资产得到更为妥善的管理。在保证基金持有人的权益受到保护的前提下，基金管理人的内部机构设置、职能划分可能会发生变化，职能也会相应的做出调整,但不会影响本基金的投资理念、投资目标、投资范围和投资运作。本基金的投资决策程序如下：

(1) 研究策划部通过自身研究及借助外部力量提供有关公司分析、行业分析、宏观分析及市场分析的各类报告,为基金的投资管理提供决策依据。

(2) 基金经理部设置不同的基金管理小组,以研究策划部提供的各类报告为主要依据各自独立拟定其所管理基金的整体投资方案,报投资决策委员会审核。

(3) 投资决策委员会根据研究策划部提出的各类报告审核基金经理部提出的投资方案,决定基金资产在各项金融工具中的分配比例,决定重点投资的行业和投资比例,不决定个股的投资方案。

(4) 基金管理小组根据投资决策委员会的决定制定具体的证券投资组合计划。

(5) 基金交易部负责执行证券投资组合计划,制定交易策略,进行具体品种的交易。

(6) 监察部对计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制,风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险控制建议。投资组合计划执行完毕后,基金经理部负责向投资决策委员会提出总结报告。

4、投资组合

1) 由于本基金由《证券投资基金暂行办法》颁布前的老基金规范后设立,经中国证监会批准,基金投资比例存在一段调整期,调整期为基金上市之日起六个月内。

调整期结束后本基金的投资组合须符合下列规定：

(1) 本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%。

(2) 本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%。

(3) 本基金持有一家上市公司的股票,不超过基金资产净值的 10%,本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的 10%。

(4) 遵守中国证监会规定的其他比例限制。

5、投资限制

本基金不得投资于其他基金;不得将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款;不得从事证券信用交易;不得进行房地产投资;不得从事可能使基金承担无限责任的投资;不得从事中国证监会规定禁止从事的其他行为。

(八) 基金专用交易席位的选用

本基金自移交基准日开始至首次扩募验资日之间,采用温州国际信托投资公司和盐城市信托投资公司的交易席位;在首次扩募验资之后,则由本基金管理人根据以下标准进行考察后确定证券经营机构的选择。

选择使用交易席位的证券经营机构的标准:

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构,使用其席位作为基金的专用交易席位。选择标准为:

(1) 证券经营机构财务状况良好,经营行为规范,风险管理先进,投资风格与基金管理人互补性,在最近一年内无重大违规行为;

(2) 该证券经营机构具有较强的研究能力,能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息,具有很强的行业分析能力,能根据基金管理人所管理的基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力。

选用交易席位的证券经营机构由基金管理人根据上述标准考察后确定。基金管理人和被选中的证券经营机构签定席位使用协议,报中国证监会备案并及时公告。

(九) 基金发起人的权利和义务

基金发起人拥有首次扩募后按约定及有关的规定持有基金单位、出席或委派代表出席基金持有人大会、取得基金收益、依法转让基金单位、监督基金经营情况,获取基金业务及财务状况的资料、参与基金清算,取得基金清算后的剩余资产等权利。

基金发起人负有公告上市公告书、首次扩募后在基金存续期间持有符合规定比例的基金单位、遵守基金契约、承担基金亏损或终止时的有限责任、不从事任何有损基金及其他基金持有人利益的活动等义务。

(十) 基金管理人的权利与义务

基金管理人拥有运用基金资产、监督基金托管人忠实履行基金的托管义务、依本契约规定获取基金管理报酬、依照有关规定,代表基金行使基金投资等权利。

基金管理人负有诚信尽责地从事基金投资、控制投资风险、保护基金利益、按规定计算并公告基金资产净值及基金单位资产净值、按规定进行信息披露、保守基金商业秘密、按规定召集基金持有人大会、保存基金会计资料、因自身过错导致基金财产损失时承担赔偿责任等义务。

(十一) 基金托管人的权利与义务

基金托管人拥有监督基金管理人的投资运作、获得基金托管费等权利。

基金托管人负有诚信尽责地保管基金资产、控制保管风险、保护基金利益、保管基金的重大合同及有关凭证、开设和保管基金资金帐户与证券帐户、从事基金清算交割、保守基金商业秘密、复核审查基金管理人计算的基金资产净值和基金单位资产净值、按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告、建立并保存基金持有人名册并负责基金单位转让的过户和登记、按有关规定保存基金会计资料、依据基金管理人的指令或有关规定向基金持有人支付基金收益、因过错导致财产损失时承担赔偿责任等义务。

(十二) 基金持有人的权利和义务

基金持有人拥有出席或委派代表出席基金持有人大会并行使表决权、取得基金收益、监督基金经营情况并获取基金业务及财务状况的资料、转让基金单位、取得基金清盘后的剩余财产等权利。每份基金单位具有同等的合法权益。

基金持有人负有遵守基金契约、交纳基金认购款项及规定的费用、承担基金亏损或者终止的有限责任、不从事任何有损基金及其他基金持有人利益的活动等义务。

(十三) 基金持有人大会

基金持有人大会依一定的事由以一定的程序召开,基金持有人大会就有关基金持有人利

益的重大事项进行讨论表决,包括:修改基金契约、提前终止基金、更换基金管理人、更换基金托管人、基金扩募、续期或转型及中国证监会规定的其他情形。基金持有人大会决议必须经出席会议的基金持有人所持表决权的半数以上通过,但更换基金管理人或托管人应由持有半数以上基金单位总额的基金持有人通过。

基金持有人大会决议对全体基金持有人、基金管理人和基金托管人具有相同约束力,基金持有人大会决议经中国证监会批准后方可生效。

(十四) 基金托管人、基金管理人更换的条件和程序

1、基金托管人的变更

有下列情形之一的,经中国证监会和中国人民银行批准,可以依一定程序更换基金托管人:

- (1) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产的;
- (2) 基金管理人认为更换基金托管人符合基金持有人利益的;
- (3) 代表 50% 以上基金单位的基金持有人要求基金托管人退任的;
- (4) 中国人民银行有充分理由认为基金托管人不能继续履行基金托管职责。

2、基金托管人更换程序

- (1) 提名:由基金管理人提名新任基金托管人
- (2) 决议:被提名的新任基金托管人经基金持有人大会通过
- (3) 批准:经中国证监会和中国人民银行审查批准后,新任基金托管人方可继任,原任基金托管人方可退任。
- (4) 公告:基金托管人更换后,由基金管理人在获得中国证监会和中国人民银行批准后 5 个工作日内公告。

新任基金托管人与原基金托管人进行资产管理交接手续,并与交接管理人核对资产总值。

3、基金管理人的更换

有下列情形之一的,经中国证监会批准,可以依一定程序更换基金管理人:

- (1) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产;
- (2) 基金托管人认为更换基金管理人符合基金持有人利益;
- (3) 代表 50% 以上基金单位的基金持有人要求基金管理人退任;
- (4) 中国证监会有充分理由认为基金管理人不能继续履行基金管理职责的。

4、更换基金管理人的程序:

- (1) 提名:更换基金管理人时,由中国证监会或基金托管人提名新任基金管理人。
- (2) 决议:基金持有人大会对被提名的新任基金管理人形成决议。
- (3) 批准:新任基金管理人经中国证监会审查批准后方可继任,原任基金管理人经中国证监会批准后方可退任。

(4) 公告:基金管理人更换后,由基金托管人在中国证监会批准后 5 个工作日内在中国证监会指定的信息披露报刊上公告。如果基金托管人和基金管理人同时更换,由基金发起人联系单位在获得批准后 5 个工作日内在中国证监会指定的信息披露报刊上公告。

(十五) 基金资产

1、基金资产总值

基金资产总值是指基金所购买各类证券价值、银行存款本息以及其他投资所形成的价值总和。

2、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去按照国家有关规定可以在基金资产中扣除的费用后的价值。

3、基金资产的帐户

本基金资产以“金越证券投资基金专户”的名义开立基金专用银行存款帐户和基金专用证券帐户，与基金管理人和基金托管人自有的资产帐户以及其他基金资产帐户相独立。

4、基金资产的处分

本基金资产应独立于基金管理人和托管人的资产，并由托管人保管。管理人、托管人以其自有的资产承担相应的法律责任，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依据《暂行办法》、本基金契约及其他有关规定处分外，基金资产不得被处分。

(十六) 基金资产估值

1、估值目的:客观、准确地反映基金资产是否保值、增值。

2、估值日:每日对基金资产进行估值。

3、估值方法:

1) 上市证券按当日平均价计算;该日无交易的证券,以最近一个交易日的平均价计算;

2) 未上市的股票(指申购新股)以其购入成本价计算;

3) 未上市国债及银行存款,以本金加计至估值日止应计利息额计算;

4) 如遇特殊情况而无法或不宜以上述规定确定资产价值时,基金管理人依照国家有关规定办理。

4、估值对象:基金所拥有的股票、债券和银行存款。

5、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金资产净值由基金管理人完成估值后,将估值结果以书面形式报给基金托管人,基金托管人按基金契约规定的估值方法、时间、程序进行复核;基金托管人复核无误后签字返回给基金管理人;月末、年中和年末估值复核与基金会计帐目的核对同时进行。

(十七) 基金费用与税收

基金费用主要有:基金管理人报酬、基金托管人托管费、基金上市费用、证券交易费用、基金信息披露费用、基金持有人大会费、会计师费用和律师费用等。

1、基金管理人的报酬

基金管理人的报酬由两部分组成,一部分是基金管理费,以基金资产净值的 1.5% 的年费率计提;另一部分是业绩报酬,当基金的可分配净收益率高于同期银行一年定期储蓄存款利率 20% 以上,且当年基金资产净值率高于同期证券市场平均收益率时,按一定比例计提。具体计提方法如下:

(1) 基金的管理费;

该项费用按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。若本基金持有现金的比例超过资产净值的 20%,超出部分不计提基金管理费。计算方法如下:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值(扣除本基金持有现金比例超过 20% 部分的基金资产净值)

基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2) 管理人业绩报酬:

业绩报酬根据基金全年的经营业绩情况而定,在同时满足如下条件的情况下每年计提一次,直接用于奖励基金管理人员:

1 基金年平均单位资产净值不能低于面值;

2 基金可分配净收益率超过同期银行一年定期储蓄存款利率 20% 以上;

3 基金资产净值增长率超过证券市场平均收益率;

4 基金收益分配后其每单位资产净值不能低于面值。

在同时满足以上条件的情况下，基金业绩报酬的计算方法为：

业绩报酬=调整后期初资产净值×Min[M,N]×5%

其中，

M=基金可分配净收益率-1.2×同期银行一年定期储蓄存款利率(如果年内利率发生变动，则按时间段进行加权平均调整)；

N=基金资产净值增长率-证券市场平均收益率；

Min [M,N] 为 M、N 中较小者；

基金可分配净收益率=当期可分配净收益/ 调整后期初资产净值；

基金资产净值增长率=(期末基金资产净值-调整后期初资产净值)/调整后期初资产净值；

调整后期初资产净值=上年度本基金资产净值-上年度已分配收益；

证券市场平均收益率=[(深证综指年涨跌幅×深市平均总市值+上证综指年涨跌幅×沪市平均总市值)/(深市平均总市值+沪市平均总市值)]×80 %+同期国债收益率×20%

深市平均总市值=(期末深市总市值+期初深市总市值)/2

沪市平均总市值=(期末沪市总市值+期初沪市总市值)/2

基金管理人业绩报酬于每个基金会计年度结束后计算，若可以提取基金业绩报酬则由基金托管人于次个基金会计年度前 20 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值(扣除本基金持有现金比例超过 20%部分的基金资产净值)

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

基金和基金持有人应根据国家有关规定依法纳税。

(十八) 基金收益与分配

基金收益包括基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、存款利息收入及其他收入，因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入基金收益。基金净收益为基金收益扣除国家有关规定可以在基金收益中扣除费用后的余额。

基金收益分配的比例不低于基金会计年度净收益的 90%；基金收益每会计年度结束后的四个月内分配一次，采取现金形式分配；基金当年收益应先弥补上一年亏损，基金投资当年亏损则不进行收益分配；每份基金单位享有同等分配权。

基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后五个工作日内公告。

(十九) 基金的会计与审计

基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

基金管理人聘请具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表进行审计。

基金管理人(或托管人)认为有充分理由更换会计师事务所时，须经基金托管人(或管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所需在五个工作日内公告。

(二十) 基金的信息披露

本基金的信息披露事项将在中国证监会指定的信息披露报刊上公告。

本基金的信息披露的内容包括：

1、基金年度报告经注册会计师审计后，在基金会计年度结束的 90 日内公告；

2、基金中期报告在基金会计年度前六个月结束后的 60 日内公告；

- 3、基金资产净值每周至少公告一次,于截止日后 1 个工作日内公告;
- 4、基金投资组合三个月至少公告一次,于截止日后 15 个工作日内公告;
- 5、临时公告;
- 6、澄清公告与说明;

基金信息披露内容文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,基金持有人可免费查阅。

(二十一)、基金的终止和清算

有下列情形之一的,基金将终止并进入清算程序:

- (1)基金封闭期满,未被批准续期或转型的;
- (2)基金经批准提前终止;
- (3)因重大违法、违规行为,基金被中国证监会责令终止。

在中国证监会监督下,由基金清算小组进行基金清算。

(二十二)基金的扩募、续期和转型

本基金由基金管理人、基金托管人协商提议,基金持有人大会通过,并经中国证监会批准,可以延长基金存续期限并扩募。

鉴于本基金是由原金信基金、温信基金、盐信基金、金信受益、浙工受益和绍信受益合并而成的,故首次扩募的时间、规模、程序,等,将根据中国证监会关于原有证券投资基金清理规范的政策及原持有人大会的决议执行。

由基金管理人、基金托管人协商提议,基金持有人大会通过,并经中国证监会批准,本基金可以由封闭式转为开放式。

(二十三)违约责任

由于本基金契约当事人的过错,造成基金契约不能履行或不能完全履行的,由有过错的一方承担违约责任;如属基金契约两方或三方当事人的过错,根据实际情况,由两方或三方承担各自应负的违约责任。

(二十四)争议的处理

本基金契约当事人发生纠纷时,可以通过协商或调解解决。基金契约当事人不愿通过协商、调解解决或协商、调解不成的,可向基金托管人所在地的人民法院起诉。

(二十五)基金契约的效力

本基金契约经各方当事人盖章以及各方法定代表人或其授权代表签字并经中国证监会批准后生效,有效期为生效日起至基金清算结束报中国证监会批准并公告之日。

(二十六)基金契约的修改和终止

基金契约的修改应经基金契约当事人同意,修改本基金契约应召开基金持有人大会,基金契约修改的内容应经基金持有人大会决议同意,本基金契约的修改应报中国证监会批准。

基金终止后,应当对基金进行清算。中国证监会对基金清算结果批准并予以公告后基金契约方能终止。

(二十七)其他

本基金契约所指的基金移交基准日为基金清理规范并合并后的移交验资日,该验资日由金越证券投资基金合并前原基金管理人和合并后新任基金管理人博时基金管理有限公司、新任基金托管人交通银行共同确定。

《基金契约》存放于基金管理人博时基金管理有限公司及基金托管人交通银行处,以供查阅。

七、基金运作情况

(一)基金管理人报告

1、金越证券投资基金改制成立后,为了争取基金长期稳定的投资收益,基金管理人将会

加强对市场的研判,精心操作,力求给投资人较好的回报。

2、基金管理人已于 1999 年 11 月 11 日开始基金投资运作,关于基金运作的具体情况,将依据有关规定,通过基金年度报告、基金中期报告、基金临时公告、基金资产净值公告和基金投资组合公告等信息披露形式披露。

3、基金管理人承诺

本基金管理人承诺勤勉尽责、诚实信用、安全有效地管理和运作基金资产,为投资者谋求最大的投资收益。

为切实履行上述承诺,保障投资人合法权益,管理人全体员工均已与公司签定了上岗承诺书,保证不从事任何法律法规及公司禁止的活动。公司任何人员,除为公司进行基金投资外,不得直接或间接进行股票交易;不得协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易;不得泄露尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。如发现上述行为,公司将根据有关规定进行处罚。

广大投资者如发现本公司员工发生上述行为,请向本公司监察稽核部举报。

举报电话:010-65171166 转监察稽核部

(二)基金托管人报告

基金托管人交通银行依据签署的《金越证券投资基金基金契约》,受理托管金越基金的全部财产,对基金投资运作进行了全面的会计核算和必要的监督。

八、财务状况

(一)基金资产已于 1999 年 11 月 8 日全部划至本基金的托管人交通银行为基金所开设的“金越证券投资基金专户”和有关证券帐户,并经浙江天健会计师事务所〔1999〕107 号验资报告,资产全部到位。11 月 10 号情况为:(单位:元)

基金单位总份额:	210,960,000.00
未分配净收益:	17,922,963.60
基金资产净值:	228,882,963.60
每份基金单位资产净值:	1.0850

(二)基金管理人将按照《基金契约》及《证券投资基金信息披露指引》的规定披露基金财务状况。

(三)财务状况

1、资产负债状况(截止 2000 年 4 月 14 日,单位:元)

银行存款:	6,434,085.27
交易保证金	77,360,449.72
股票投资:	180,781,646.16
债券投资:	0.00
资产估值增值:	57,201,339.94
其他应收款:	260,870.47
基金资产总值:	322,038,391.56
应付管理人报酬:	183,810.02
应付托管费:	30,635.02
其他应付款:	5,326,166.30
负债合计:	5,540,611.34
实收基金:	210,960,000.00
已实现净收益:	31,058,328.58
收益分配:	17,278,111.70
未实现资本利得:	57,201,339.94

持有人权益合计： 316,497,780.22

基金资产净值： 316,497,780.22

每份基金单位资产净值： 1.5003

注：上述披露的本基金财务数据未经审计。

2、重要财务事项

(1) 净收益主要是证券买卖差价收入和银行利息收入。

(2) 未实现投资收益是指基金资产的估值增值

上市证券以计算日市场平均价为准；该日无交易的，以最近的交易日平均价为准；未上市的股票以发行价计算；未上市的债券以本金加计至估值日止应计利息计算；

3、资产净值计算方法：

资产净值=实收基金+净收益+未实现投资收益

九、风险揭示

本基金的投资也存在风险，主要有：

(一) 市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响所引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如业内竞争、市场前景、管理能力、财务状况等都会导致公司盈利发生变化。

5、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

6. 扩募风险

本基金上市后既行扩募，由于基金规模的扩大将导致基金单位净值的下降，引起基金市场价格的波动，从而产生风险。

(二) 管理风险

在基金的管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误，及获取的信息不全等影响基金的收益水平。同时基金管理人和托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平也存在相关的影响。

(三) 其它风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

十、重要事项揭示

(一) 基金发起人持有基金单位份额情况：

由于历史原因，本基金发起人博时基金管理有限公司未持有本基金份额。按照有关规定，

博时基金管理有限公司将于首次扩募时认购不低于基金总规模 1% 的基金份额，且在基金存续期内持有比例不低于本基金总规模的 0.5%，其余部分在基金扩募部分上市二个月后方可流通。

(二) 本基金 21096 万份基金单位将于 2000 年 4 月 24 日在深圳证券交易所挂牌上市。

(三) 基金的首次扩募续期已经原基金持有人大会通过，首次扩募续期不再需要召开基金持有人大会。

(四) 本基金管理人已经持有人大会授权，向中国证券监督管理委员会提出扩募至 5 亿份基金单位的申请，该申请已获批准。本基金将于上市后 5-30 个工作日内，由原来的 21096 万份基金单位扩募到 5 亿份基金单位，以每份基金单位价格 1.01 元向原持有人按比例配售，基金发起人按规定认购，原持有人及基金发起人认购后剩余部份由商业保险公司认购。

(五) 本基金在扩募到 5 亿份基金单位规模后，更名为裕华证券投资基金，基金存续期延长 5 年(至 2007 年 7 月)。

(六) 本基金原管理人声明如下：

(1) 本公司已提交了金越证券投资基金规范、合并和移交有关的以及可能对基金规范、合并和移交产生影响的所有资料、文件和信息；

(2) 本公司所提供文件资料，如为副本/ 复印件，均经本公司与原件核对无误；

(3) 本公司所提供的文件、资料均为真实、完整和准确，而没有任何虚假、不实、错误或者重大遗漏；

(4) 截至本声明签署日，金越基金资产真实、完整、独立，不存在任何诉讼、仲裁或行政处罚案件；

(5) 由于历史原因和基金操作中的不规范，本公司将部分基金资产以个人名义开立资金帐户和证券帐户从事证券投资，本公司提供给各中介机构查证的以个人名义开设的资金帐户和证券帐户上的资金和股票，确系基金资产。

(七) 本基金原管理人承诺：将所有原基金有关资料及会计帐册保存 15 年以上，以备查询。

(八) 本基金上市首日设涨跌幅限制，限制幅度为 2000 年 4 月 21 日基金单位净值的 30%。2000 年 4 月 21 日基金单位净值将在 2000 年 4 月 22, 24 两天的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公布。

十一、备查文件

1、中国证监会〈关于浙江省原有投资基金清理规范实施方案的文件〉

2、原金信基金、温信基金、盐信基金、金信受益、浙工受益和绍信受益 1999 年度临时持有人大会决议

3、中国证监会《关于金越证券投资基金上市、扩募、更名和续期的批复》

4、金越证券投资基金基金契约

5、金越证券投资基金托管协议

6、基金上市法律意见书

7、基金发起人营业执照

8、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9、基金托管人业务资格批件和营业执照

博时基金管理有限公司

2000 年 4 月 19 日